

测度与概率 Notes

Liu Fuzhou

2025 年 2 月 7 日

前言

要看偏微分方程，就要先看泛函分析。要看泛函分析，就要先看实分析。泛函分析和实分析对随机分析也是重要的。无论如何也绕不开 L^p 空间。可见掌握实分析十分重要。以前其实也看过这个主题的书，结果后来都忘了。看来做一些有形的笔记是很有必要的。不需要特别详细，提纲挈领即可。

主要参考文献：

1. 近代概率引论：测度、鞅和随机微分方程。袁震东。科学出版社，1991.
2. 测度与概率教程。任佳刚，巫静。科学出版社，2018.
3. Measure, Integration & Real Analysis. Sheldon Axler. Springer, 2020.

Liu Fuzhou

2025 年 2 月 7 日

目录

1	集列的极限	1
2	Riemann 积分	1
3	Riemann 积分的若干缺陷	5
4	外测度	7
5	外测度的缺点：不可加性	9
6	可测空间与可测函数	13

插图

3.1	Graph of the piecewise function $f_n(x)$ depicted by equation	
	(17) for $n = 3$	7

1. 集列的极限 首先比较重要的概念就是集列的上极限与下极限. 集列 $\{A_n\}_{n \in \mathbb{N}}$ 的上极限就是落到其中无限多个集合的元素所做成的集合, 也即 $\limsup_{n \rightarrow \infty} A_n = \bigcap_{n=1}^{\infty} \bigcup_{k=n}^{\infty} A_k$. 下极限就是除去有限多个集合后, 落到所有集中的元素所做成的集合, 也即 $\liminf_{n \rightarrow \infty} A_n = \bigcup_{n=1}^{\infty} \bigcap_{k=n}^{\infty} A_k$. 换言之也即“最终落到集列” A_n 中的那些元素之全体. 显然, 下限集中的元素也都落到上限集之中, 也即 $\liminf A_n \subset \limsup A_n$. 如果集列 A_n 的上限集与下限集相等, 那么就说集列 A_n 收敛, 并称 $A = \liminf A_n = \limsup A_n$ 为集列 A_n 的极限. 这个极限是关于集合包含的偏序关系说的. 与实数的情况类似, 有单调集列的收敛定理: 如果 $A_n \uparrow$ 是单调递增的, 那么 $\lim A_n = \bigcup_n A_n$. 类似地, 如果 $A_n \downarrow$ 是单调递减的, 那么 $\lim A_n = \bigcap_n A_n$.

例 1.1. 设 $\{A_n\}_{n \in \mathbb{N}}$ 为单调减少集列. 证明

$$A_1 = \sum_{n=1}^{\infty} (A_n - A_{n+1}) + \bigcap_{n=1}^{\infty} A_n$$

证明. 首先, 右边的每个集合都含于 A_1 . 因此右边含于 A_1 . 其次, 若 $x \in A_1$ 且 $x \notin \bigcap_{n=1}^{\infty} A_n$, 则 $x \in \sum_{n=1}^{\infty} (A_n - A_{n+1})$ 且 $x \notin \bigcap_{n=1}^{\infty} A_n$. 因此 A_1 也是单调递减的. 最后, 若 $x \in \bigcap_{n=1}^{\infty} A_n$, 则存在某个 $n > 1$, 使得 $x \notin A_n$. 令 n_0 为最小的这种 n , 那么就有 $x \notin A_{n_0}$, $x \in A_{n_0-1}$. 于是就有 $x \in \sum_{n=1}^{\infty} (A_n - A_{n+1})$. 这就证明了 $A_1 \subset \sum_{n=1}^{\infty} (A_n - A_{n+1}) + \bigcap_{n=1}^{\infty} A_n$. \square

2. Riemann 积分 还是用 [1] 作为参考书比较好, 还是彩色的. 我还是比较喜欢 Riemann 积分的, 最开始是在梅加强的书上学的. 比较重要的技术就是证明 Darboux 上和总是大于等于 Darboux 下和那里, 需要用到两个 partition 的 merge. 也就是说, 用到了有界闭区间的 partition 全体构成一个 directed set 的性质. Darboux 上和与 Darboux 下和之差就是所谓的函数振幅 $\Omega_{\mathcal{P}}(f) = \sum_i (\sup_{x_{i-1} \leq x \leq x_i} f - \inf_{x_{i-1} \leq x \leq x_i} f)(x_i - x_{i-1})$, 这里 $\mathcal{P} = \{a = x_0 < x_1 < \cdots < x_n = b\}$ 是所讨论的具体的分割.

如果向 partition 的点集增加元素, 也即使得分割变得更细, 那么结果就是上和不变, 下和不变. 这就导致了两个极限 $\lim_{\mathcal{P}} \mathcal{L}(f, \mathcal{P}, [a, b])$ 和

$\lim_{\mathcal{P}} \mathcal{U}(f, \mathcal{P}, [a, b])$, 称为 Riemann 下积分 $\int_a^b f(x) dx$ 和上积分 $\overline{\int}_a^b f(x) dx$. 这两个极限是关于 partition 全体所具有的 directed set 结构说的, 也就是说 net 的极限. 由于下和不大于上和, 也即 $\mathcal{L} \leq \mathcal{U}$, 因此这两个极限之间也有关系

$$\int_a^b f(x) dx \leq \overline{\int}_a^b f(x) dx \quad (1)$$

如果 Riemann 上下积分相等, 就说 f 在 $[a, b]$ 上 Riemann 可积, 其积分 $\int_a^b f(x) dx$ 就定义为上下积分的共同值.

任意分割 \mathcal{P} 都将区间 $[a, b]$ 分成 $\#(\mathcal{P})-1$ 个首尾相接的闭区间 $[x_0, x_1], \dots, [x_{n-1}, x_n]$. 从每个闭区间挑选一个元素出来, 就可以做成一个集合 Δ . 这种挑选当然是不唯一的. 称这种通过在每个闭区间中挑出一个元素所形成的集合为与 partition \mathcal{P} 相伴的一个点集. 设 $\{\mathcal{P}_n\}_{n \in \mathbb{N}}$ 是任意一系列 partition, 并且 $\{\Delta_n\}_{n \in \mathbb{N}}$ 是一列与之相伴的点集, 每个 Δ_n 中元素形如 $\Delta_n = \{\xi_1, \dots, \xi_{\#(\mathcal{P}_n)-1}\}$, 那么就可以考虑 Riemann 和所形成的数列

$$\mathcal{R}_n := \mathcal{R}(f, \mathcal{P}_n, \Delta_n, [a, b]) = \sum_{i=1}^{\#(\mathcal{P}_n)-1} f(\xi_i)(x_i - x_{i-1}) \quad (2)$$

显然有 $\mathcal{L}(f, \mathcal{P}_n, [a, b]) \leq \mathcal{R}_n \leq \mathcal{U}(f, \mathcal{P}_n, [a, b])$. 因此有

$$\int_a^b f(x) dx \leq \liminf \mathcal{R}_n \leq \limsup \mathcal{R}_n \leq \overline{\int}_a^b f(x) dx \quad (3)$$

这就表明, 如果 \mathcal{R}_n 有收敛子列的话, 那么该子列的极限就必定位于上下积分之间. 当然了, 如果 f 是 Riemann 可积的, 这个极限就必定等于 $\int_a^b f(x) dx$.

以上讨论了利用 partition 的全体所组成的集合之上的 directed set 结构来定义的 Riemann 积分. 下面考虑利用 Riemann 和关于 partition 的 mesh 的极限的途径. 这就是说, 把 Riemann 积分定义为极限

$$\lim_{\|\mathcal{P}\| \rightarrow 0} \mathcal{R}(f, \mathcal{P}, \Delta, [a, b]) \quad (4)$$

其中 $\|\mathcal{P}\| = \max_i |x_i - x_{i-1}|$ 是 partition 的 mesh. 这个极限其实相当强, 因为其定义只涉及 partition, 对相伴的点集 Δ 没什么要求.

由不等式 (3) 可知, 如果两种定义下的 Riemann 积分均存在, 那么它们的值必定相等. 因此, 两种定义的等价性的证明就归结于证明其存在性的等价性.

要证明两种定义的等价性, 首先要注意到, 上下积分之差恰好等于函数振幅的下确界 $\inf_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f)$. 这就是说 $\lim_{\mathcal{P}} (\mathcal{U}(f, \mathcal{P}, [a, b]) - \mathcal{L}(f, \mathcal{P}, [a, b])) = \inf_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f)$, 或者说 $\lim_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f) = \inf_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f)$. 事实上, 设 $\varepsilon > 0$, 那么由 net 的极限的定义, 存在 partition \mathcal{P}_0 , 使得任意细于 \mathcal{P}_0 的分割 \mathcal{P} 都满足 $|\Omega_{\mathcal{P}_0}(f) - \lim_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f)| < \varepsilon$. 另一方面, 由下确界的定义, 存在 partition \mathcal{P}_1 使得 $\Omega_{\mathcal{P}_1}(f) < \inf_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f) + \varepsilon$. 取分割 \mathcal{P}_2 为 \mathcal{P}_0 与 \mathcal{P}_1 的 merge, 那么就有

$$\lim_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f) - \varepsilon < \Omega_{\mathcal{P}_2}(f) \leq \Omega_{\mathcal{P}_1}(f) < \inf_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f) + \varepsilon \quad (5)$$

于是 $\inf_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f) \leq \lim_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f) < \inf_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f) + 2\varepsilon$. 这就证明了

$$\overline{\int_a^b} f(x) \, dx - \underline{\int_a^b} f(x) \, dx = \inf_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f) \quad (6)$$

假如极限 (4) 存在, 其值记为 A , 那么对于任意的 $\varepsilon > 0$, 存在 $\delta > 0$, 使得只要 partition 的 mesh 小于 δ , 就有 $|\mathcal{R}(f, \mathcal{P}, \Delta, [a, b]) - A| < \varepsilon$. 现在固定分割 \mathcal{P} , 那么由于该不等式对于任意与 \mathcal{P} 相伴的点集 Δ 都成立, 因此有 $\Omega_{\mathcal{P}}(f) \leq 2\varepsilon$. 这就证明了 $\inf_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f) = 0$, 因而上下积分相等.

反之, 要从上下积分相等导出极限 (4) 的存在性, 还需要证明一个基于 partition 的 mesh 估计的技术性引理:

引理 2.1. 设 $\mathcal{P}, \mathcal{P}'$ 为区间 $[a, b]$ 的两个 partition, $M = \sup_{x \in [a, b]} |f(x)|$, 那么就有不等式

$$\Omega_{\mathcal{P}}(f) \leq \Omega_{\mathcal{P}'}(f) + (\#(\mathcal{P}') - 2)M\|\mathcal{P}\| \quad (7)$$

事实上, 如果向 \mathcal{P} 中添加一个新元素 y , 譬如说插入到区间 $[x_k, x_{k+1}]$ 中, 那么所形成的新分割 \mathcal{P}'' 的 Darboux 和与 \mathcal{P} 的 Darboux 的差异仅来

自于区间 $[x_k, x_{k+1}]$ 的贡献, 也即

$$\Omega_{\mathcal{P}''}(f) - \Omega_{\mathcal{P}}(f) = \omega_{x_k \leq x \leq y} f(x)(y - x_k) + \omega_{y \leq x \leq x_{k+1}} f(x)(x_{k+1} - y) - \omega_{x_k \leq x \leq x_{k+1}} f(x)(x_{k+1} - x_k) \quad (8)$$

考虑到 $\omega_{x_k \leq x \leq y} - \omega_{x_k \leq x \leq x_{k+1}}$ 和 $\omega_{y \leq x \leq x_{k+1}} - \omega_{x_k \leq x \leq x_{k+1}}$ 都落到区间 $[-M, M]$ 内, 因此 $\Omega_{\mathcal{P}''}(f) - \Omega_{\mathcal{P}}(f)$ 的绝对值被 $M(x_{k+1} - x_k)$ 控制, 从而也被 $M\|\mathcal{P}\|$ 控制. 这就导出了 $|\Omega_{\mathcal{P}''}(f) - \Omega_{\mathcal{P}}(f)| \leq M\|\mathcal{P}\|$. 类似地, 如果向 \mathcal{P}'' 中再插入一个新元素得到新分割 \mathcal{P}''' , 那么同样有

$$|\Omega_{\mathcal{P}'''}(f) - \Omega_{\mathcal{P}''}(f)| \leq M\|\mathcal{P}''\| \quad (9)$$

由于 \mathcal{P}''' 细于 \mathcal{P} , 因此 $\|\mathcal{P}'''\| \leq \|\mathcal{P}\|$. 因此 $\Omega_{\mathcal{P}'''}(f) - \Omega_{\mathcal{P}''}(f)$ 的绝对值也被 $M\|\mathcal{P}\|$ 控制, 从而有 $|\Omega_{\mathcal{P}'''}(f) - \Omega_{\mathcal{P}}(f)| \leq 2M\|\mathcal{P}\|$. 现在考虑 \mathcal{P} 与 \mathcal{P}' 的 merge \mathcal{S} , 其可以通过反复向 \mathcal{P} 中插入元素来得到, 插入次数至多为 $\#(\mathcal{P}') - 2$ 次. 因此就有

$$\Omega_{\mathcal{P}}(f) - (\#(\mathcal{P}') - 2)M\|\mathcal{P}\| \leq \Omega_{\mathcal{S}}(f) \leq \Omega_{\mathcal{P}'}(f) \quad (10)$$

这就导出了不等式 (7). 这个引理最初是在 [3] pp.213 看到的.

作为引理 2.1 的一个推论, 立刻可以导出

$$\lim_{\|\mathcal{P}\| \rightarrow 0} \Omega_{\mathcal{P}}(f) = \inf_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f) \quad (11)$$

这是因为, 设 $\varepsilon > 0$, 那么由下确界的定义可知存在 partition \mathcal{P}_0 , 使得 $\Omega_{\mathcal{P}_0}(f) < \inf_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f) + \varepsilon$. 记 $N = \#(\mathcal{P}_0) - 2$, 那么当 partition 的 mesh 小于 $\varepsilon/(MN)$ 时, 由引理 2.1 可知

$$\Omega_{\mathcal{P}}(f) \leq \Omega_{\mathcal{P}_0}(f) + (\#(\mathcal{P}') - 2)M\|\mathcal{P}\| < \inf_{\mathcal{P}} \Omega_{\mathcal{P}}(f) + 2\varepsilon \quad (12)$$

这就证明了 (11) 式. 类似地可以证明

$$\lim_{\|\mathcal{P}\| \rightarrow 0} \mathcal{L}(f, \mathcal{P}, [a, b]) = \int_a^b f(x) \, dx, \quad \lim_{\|\mathcal{P}\| \rightarrow 0} \mathcal{U}(f, \mathcal{P}, [a, b]) = \overline{\int}_a^b f(x) \, dx. \quad (13)$$

现在假设 Riemann 上下积分相等, 也即 $\lim_{\|\mathcal{P}\| \rightarrow 0} \Omega_{\mathcal{P}}(f) = 0$, 那么对于任意的 $\varepsilon > 0$, 存在 $\delta > 0$, 使得只要 partition 的 mesh 小于 δ , 就有 $|\mathcal{U} - \overline{\mathcal{J}}|, |\mathcal{L} - \underline{\mathcal{J}}| < \varepsilon$. 自然, 此时由不等式 (13) 可知

$$\int_a^b f(x) dx - \varepsilon < \mathcal{L}(f, \mathcal{P}, [a, b]) \leq \mathcal{R}(f, \mathcal{P}, \Delta, [a, b]) \leq \mathcal{U}(f, \mathcal{P}, [a, b]) \leq \int_a^b f(x) dx + \varepsilon \quad (14)$$

这就证明了极限 (4) 的存在性.

容易验证闭区间上的连续函数是 Riemann 可积的. 这主要用到了其一致连续性.

3. Riemann 积分的若干缺陷 Riemann 积分的一些缺陷:

1. 如果函数的连续性较差, 则其 Riemann 可积性也较差: 典型的例子就是 Dirichlet 函数.
2. 无界函数的 Riemann 可积性较差 (反常积分): 一个例子就是取一列可求出瑕积分的函数 $f_k(x)$, 使得每个函数的瑕点恰好对应区间 $[0, 1]$ 上的一个有理数, 最终导致无法通过划分区间的办法求出函数 $f := \sum_k \frac{f_k}{2^k}$ 的瑕积分. 这里其实是说, 如果将面积的次可加性推广到可数的情况, 那么通常的 Riemann 积分就不太够用了. 毕竟这样构造出的 f 多多少少是个较为奇怪的函数, 这种例子更偏向于理论意义.
3. Riemann 积分与极限的可交换性较差: 这个问题看起来是最为致命的. 可以构造出一列函数 f_k , 它们的 Riemann 积分均为零, 但其逐点收敛到 Dirichlet 函数. 虽然可以证明, 如果一致有界的可积函数列的逐点极限函数是 Riemann 可积的, 那么其积分与极限可以交换位置, 也即 $\lim_n \int_a^b f_n = \int_a^b \lim_n f_n$, 但其证明却非常复杂, 并且也绕不过使用测度的思想. 这个缺陷使得 Riemann 积分在理论上使用起来尤为不便.

例 3.1. 定义闭区间 $[0, 1]$ 上的函数 f 为

$$f(x) = \begin{cases} 0, & \text{若 } x \text{ 为无理数} \\ \frac{1}{n}, & \text{若 } x \text{ 为有理数, 且 } n \text{ 为形如 } x = \frac{m}{n} \text{ 的表达式中的最小正整数 } n \end{cases} \quad (15)$$

证明 f 是 Riemann 可积的, 并计算其积分值.

显然 f 的每一个 Darboux 下和都为零, 因此 $\int_0^1 f = 0$. 下面证明 f Riemann 可积. 只需构造出一列 partition \mathcal{P}_n , 使得 $\lim_n \Omega_{\mathcal{P}_n}(f) = 0$ 即可. 由于 $\mathcal{L} \equiv 0$, 因此只需证明 $\lim_n \mathcal{U}(f, \mathcal{P}_n, [0, 1]) = 0$. 事实上, 对于任意的 n , 满足 $f(x) = 1/n$ 的 $[0, 1]$ 内的有理数至多有 $n+1$ 个, 因此其数目有限. 自然, 可以适当地区分区间, 得到分割 \mathcal{P}_n , 使得满足 $f(x) \geq 1/n$, 也即 $f(x) = 1, 1/2, \dots, 1/n$ 的全体有理数 x 所在的区间的总长不超过 $1/n$. 自然, f 在剩下的那些区间上的上确界均小于 $1/n$. 于是就有

$$\begin{aligned} \mathcal{U}(f, \mathcal{P}_n, [0, 1]) &= \sum_{f(x) \geq 1/n \text{ 的 } x \text{ 所在区间 } [x_{i-1}, x_i]} \sup_{x_{i-1} \leq x \leq x_i} f(x)(x_i - x_{i-1}) \\ &\quad + \sum_{\text{其余区间 } [x_{i-1}, x_i]} \sup_{x_{i-1} \leq x \leq x_i} f(x)(x_i - x_{i-1}) \\ &< \frac{1}{n} - \frac{1}{n} \left(1 - \frac{1}{n}\right) \\ &= \frac{2}{n} - \frac{1}{n^2} \end{aligned} \quad (16)$$

于是就有 $\lim_n \mathcal{U}(f, \mathcal{P}_n, [0, 1]) = 0$. 因此 f 是 Riemann 可积的, 并且其 Riemann 积分为 $\int_0^1 f = 0$.

例 3.2. Riemann 积分与极限交换时, 一致有界条件不可去掉.

事实上, 构造单位区间 $[0, 1]$ 上的连续函数列

$$f_n(x) = \begin{cases} n^2 x, & \text{若 } 0 \leq x \leq 1/n \\ 2n - n^2 x, & \text{若 } 1/n < x \leq 2/n \\ 0 & \text{若 } x > 2/n \end{cases} \quad (17)$$



图 3.1: Graph of the piecewise function $f_n(x)$ depicted by equation (17) for $n = 3$.

那么就有 $\int_0^1 f_n = 1$, 以及 $\lim_n f_n(x) \equiv 0$. 这是因为 $f_n(x)$ 也就只在开区间 $(0, 2/n)$ 上不为零, 该区间随着 $n \rightarrow \infty$ 而消失. 因此, 极限函数 $f := \lim_n f_n$ 是连续的, 并且有 $\int_0^1 f = 0$. 因此

$$\lim_n \int_0^1 f_n = 1 \neq 0 = \int_0^1 \lim_n f_n \quad (18)$$

当然, f_n 不是一致有界的: $\sup_{x \in [0,1]} f_n(x) = n$, 因此 $f_n(x)$ 不可能被某个有限的数所一致控制.

4. 外测度 外测度的概念是经典的: 对 \mathbb{R} 的任意子集 A , 都可定义其外测度 $|A|$ 为覆盖 A 的开区间列的总长度之下确界, 也即 $|A| = \inf_{A \subset \bigcup_n I_n} \sum_n \ell(I_n)$. 这总是定义良好的. 如果某个 $\ell(I_n)$ 为 $+\infty$, 那么显然 $\sum_n \ell(I_n) = +\infty$. 反之, $\sum_n \ell(I_n)$ 是一个非负项的数项级数. 自然, 非负项级数要么收敛, 要么发散到 $+\infty$. 因此, 如果将 $+\infty$ 也作为一个合法的长度值, 那么 $\sum_n \ell(I_n)$ 总是有定义的, 并且总是大于等于零. 因此任意的实数集 A 的外测度总是有定义的.

例 4.1. 可数集的外测度为零.

设 $A = \{a_n\}_{n \in \mathbb{N}}$, $\varepsilon > 0$, 那么可以构造区间列 $I_n = (a_n - \varepsilon/2^n, a_n + \varepsilon/2^n)$,

使得 $A \subset \bigcup_n I_n$, 于是

$$|A| \leq \sum_n \ell(I_n) = \sum_n \frac{\varepsilon}{2^{n-1}} = 2\varepsilon \quad (19)$$

这就证明了 $|A| = 0$.

特别的, 有理数集 \mathbb{Q} 的外测度为零. 这表明外测度的性质至少要比 Jordan 测度要好, 因为 $\mathbb{Q} \cap [0, 1]$ 的 Jordan 测度正是 Dirichlet 函数的 Riemann 积分, 因而不存在的.

如果实数集 A 含于 B , 那么任意覆盖了 B 的开区间列也覆盖了 A , 因而 $|A| \leq |B|$. 因此外测度与集合的包含关系的相容性良好. 此外, 由于平移变换并不改变开区间的长度, 并且将开区间变为开区间, 并且还是可逆的, 因此任意实数集 A 平移 t 距离后, 其外测度保持不变: $|A + t| = |A|$. 这就是说外测度具有平移不变性.

外测度最为重要的一条性质恐怕就是次可数可加性了.

定理 4.2. 外测度具有次可数可加性: $|\bigcup_n A_n| \leq \sum_n |A_n|$.

首先, 如果某个集合 A_n 的外测度为 $+\infty$, 那么结论显然成立. 下面假设所有 $|A_n|$ 都是有限的. 设 $\varepsilon > 0$. 对于任意固定的 n , 根据外测度的定理, 可以找到一列开区间 $\{I_{n,k}\}_{k \in \mathbb{N}}$, 使得

$$\sum_k \ell(I_{n,k}) < |A_n| + \frac{\varepsilon}{2^n} \quad (20)$$

自然, 记所有这些区间 $I_{n,k}$ 所做成的集合为 X , 那么映射 $\mathbb{N} \times \mathbb{N} \rightarrow X$, $(n, k) \mapsto I_{n,k}$ 可以重新排列顺序为 $\mathbb{N} \rightarrow X$, $j \mapsto I_{n(j), k(j)}$. 这一列区间 $I'_j := I_{n(j), k(j)}$ 覆盖了 $\bigcup_n A_n$, 并且对于每个正整数 $p \in \mathbb{N}$, 记 $n(1), \dots, n(p)$ 中的最大值为 $N(p)$, 则有

$$\sum_{j=1}^p \ell(I'_j) \leq \sum_{n=1}^{N(p)} \sum_k \ell(I_{n,k}) \leq \sum_n \sum_k \ell(I_{n,k}) < \sum_n |A_n| + \varepsilon \quad (21)$$

于是 $\sum_j \ell(J_j) \leq \sum_n |A_n| + \varepsilon$. 这就证明了

$$\left| \bigcup_n A_n \right| \leq \sum_n |A_n| \quad (22)$$

作为一个简单推论, 外测度也具有次有限可加性: $|A_1 \cup \cdots \cup A_n| \leq \sum_{i=1}^n |A_i|$.

下面来计算有界区间的外测度. 从几何上来看, 开区间 (a, b) 的外测度应该就等于其长度 $b - a$. 严格的证明稍微麻烦一些, 需要借助有界闭区间的紧性. 首先, (a, b) 与 $[a, b]$ 的外测度相同: $|(a, b)| \leq |[a, b]| \leq b - a$, 并且由 $[a, b] \subset (a - \varepsilon, b + \varepsilon)$, 以及 $|(a - \varepsilon, b + \varepsilon)| \leq |(a, b)| + 2\varepsilon$ 可得 $[a, b] \leq (a, b)$. 这就证明了开区间 (a, b) 的外测度与其闭包相同. 另一方面, 由 $[a, b]$ 的紧性可知, 任意覆盖了 $[a, b]$ 的开区间列 I_n 都存在有限子覆盖 J_1, \dots, J_p . 下面只需证明 $\sum_{i=1}^p \ell(J_i) \geq b - a$ 即可. 最简单的证法是用归纳法 ([1] pp. 20). 当 $p = 1$ 时结论显然成立. 假设该结论对 $p \leq k$ 成立, 那么当 $p = k + 1$ 时, 设 $[a, b]$ 被开区间 J_1, \dots, J_p 中的某个 $J_s = (c, d)$ 所覆盖, 那么若 $c \leq a$, 则 $\ell((c, d)) \geq b - a$, 故结论成立. 若 $c > a$, 则闭区间 $[a, c]$ 被 k 个开区间 $\{J_i\}_{1 \leq i \leq p, i \neq s}$ 所覆盖, 于是由归纳假设即知 $\sum_{i \neq s} \ell(J_i) \geq c - a$. 于是就有 $\sum_{i=1}^p \ell(J_i) \geq (c - a) + (b - c) = b - a$, 因此总是有 $\sum_n \ell(I_n) \geq b - a$. 这就证明了 $|[a, b]| = b - a$, 因而开区间 (a, b) 的外测度也等于 $b - a$.

利用区间的外测度还可以给出区间的不可数性的另一个证明.

例 4.3. 非空区间是不可数的.

事实上, 由于可数集的外测度为零, 而非空区间的外测度都大于零, 因而非空区间不可能是可数集. 这就证明了结论.

5. 外测度的缺点：不可加性 Vitali 提供了集合的不交并的外测度不等于各自外测度之和的一个例子.

例 5.1. 存在不交的实数集 A 和 B , 使得 $|A \cup B| \neq |A| + |B|$.

对于区间 $[-1, 1]$ 内的任意实数 a , 定义相伴的集合 \tilde{a} 为 $[-1, 1]$ 内所有与 a 只相差一个有理移位的元素之全体, 那么若 $\tilde{a} \cap \tilde{b} \neq \emptyset$, 譬如说 $c \in \tilde{a} \cap \tilde{b}$,

那么就有 $a - c, b - c \in \mathbb{Q}$. 因此 a, b 本身就只相差一个有理移位. 因此对于任意实数来说, 与 a 的距离为有理数当且仅当与 b 的距离为有理数, 从而有 $\tilde{a} = \tilde{b}$. 自然, 由 $a \in \tilde{a}$ 可知 $[-1, 1] \subset \bigcup_{a \in [-1, 1]} \tilde{a}$. 利用选择公理可从集合簇 $\{\tilde{a}\}_{a \in [-1, 1]}$ 中的每个集合中取出一个元素, 做成一个新集合 V . 令 $[-2, 2]$ 内的全体有理数所做成的数列为 r_1, r_2, \dots , 那么就有 $[-1, 1] \subset \bigcup_k (r_k + V)$. 这是因为对于 $[-1, 1]$ 中的任意元素 a , 设 V 所含的 \tilde{a} 中元素为 x , 则有 $a - x \in \mathbb{Q} \cap [-2, 2]$, 因而 $a - x$ 等于某个 r_k , 于是 $a \in \bigcup_k (r_k + V)$. 由外测度的次可数可加性和平移不变性即知

$$2 = |[-1, 1]| \leq \sum_k |r_k + V| = \sum_k |V| \quad (23)$$

这表明 V 的外测度必定大于零. 容易验证集列 $\{r_k + V\}_{k \in \mathbb{N}}$ 是互不相交的. 这是因为, 若 $x \in (r_{k_1} + V) \cap (r_{k_2} + V)$, 其中 $r_{k_1} \neq r_{k_2}$, 那么存在实数 a, b , 使得 $x - r_{k_1} \in \tilde{a} \cap V$, $x - r_{k_2} \in \tilde{b} \cap V$. 自然, $x - r_{k_2} = x - r_{k_1} + (r_{k_1} - r_{k_2})$ 也落入 \tilde{a} 中, 这就表明 \tilde{a} 与 \tilde{b} 相交, 于是 $\tilde{a} = \tilde{b}$. 由 V 的定义即知 $x - r_{k_1} = x - r_{k_2}$, 这就导出了 $r_{k_1} = r_{k_2}$, 矛盾!

由于 $r_k \in [-2, 2]$, $V \subset [-1, 1]$, 因此 $\bigcup_k (r_k + V) \subset [-3, 3]$. 于是 $|\bigcup_k (r_k + V)| \leq 6$. 另一方面, 由于 $|V| > 0$, 因此必定存在 $n \in \mathbb{N}$, 使得

$$\left| \bigcup_{k=1}^n (r_k + V) \right| < n|V| = \sum_{k=1}^n |r_k + V| \quad (24)$$

特别的, 如果对于任意的不交的实数集 A, B , 均有等式 $|A \cup B| = |A| + |B|$, 那么以上不等式必定不成立. 因此必定存在不交的集合 A, B , 使得其并集的外测度不等于各自外测度之和.

例 5.2. 若 \mathbb{R} 的一簇闭子集的交集为空集, 并且其中某个集合有界, 那么该集合簇中可以找到有限个集合, 使得其交集为空集.

事实上, 设 $\bigcap_{F \in \mathcal{A}} F = \emptyset$, 那么 $\{F^C\}_{F \in \mathcal{A}}$ 就是 \mathbb{R} 的一个开覆盖. 设其中的 $F \in \mathcal{A}$ 有界, 那么其为紧集, 故存在有限多个 F_1^C, \dots, F_n^C 覆盖了 F .

自然, F_1^C, \dots, F_n^C, F^C 就是 \mathbb{R} 的一个有限开覆盖, 从而有

$$F_1 \cap \dots \cap F_n \cap F = \emptyset \quad (25)$$

例 5.3. 若 I_1, I_2, \dots 为一列互不相交的开区间, 则有 $|\bigcup_n I_n| = \sum_n \ell(I_n)$.

左 \leq 右是明显的. 下面证明左 \geq 右. 设 J_n 是一列覆盖了 $\bigcup_n I_n$ 的开区间, 那么对于每个 n , 可定义开区间 (包括空集) 列 $\{J_{n,k}\}_{k \in \mathbb{N}}$ 为 $J_{n,k} := J_k \cap I_n$. 自然, $\{J_{n,k}\}_{k \in \mathbb{N}}$ 覆盖了 I_n , 于是有 $\sum_k \ell(J_{n,k}) \geq |I_n| = \ell(I_n)$. 由于 I_n 互不相交, 因此对于任意固定的 m , 可以验证 $\ell(J_k) \geq \sum_{n=1}^m \ell(J_k \cap I_n)$. 不妨将其写为一个引理:

引理 5.4. 设 I 为开区间, K_1, \dots, K_n 为互不相交的开区间, 那么 $\ell(I) \geq \sum_{k=1}^n \ell(I \cap K_n)$.

事实上, 若 I 退化或者为空集, 那么结论显然成立. 下面设 $I = (a, b)$ 非退化, 将 $I \cap K_n$ 中的非退化区间的左端点做成一个集合, 并进行排序, 得到数组 $a_1 < a_2 < \dots < a_m$, 将右端点也做成一个集合, 排序为 $b_1 < b_2 < \dots < b_m$. 那么由于 K_i 两两不交, 因此必定有

$$a \leq a_1 < b_1 \leq a_2 < b_2 \leq \dots \leq a_m < b_m \leq b \quad (26)$$

也就是说, 如果令 $b_0 := a$, 那么就有 $b_{i-1} \leq a_i < b_i$, $i = 1, 2, \dots, m$. 这是因为, 对于两个不交的非退化开区间 $(c, d), (c', d')$ 来说, 由 $c \leq d'$ 即可导出 $c < d \leq c' < d'$, 类似地由 $c \geq d'$ 也可导出 $c' < d' \leq c < d$. 现在由于 $a_1 < a_2 < \dots < a_m$, 因此如果记 a_i 所对应的区间右端点为 \tilde{a}_i , 则有 $a_{i-1} < a_i < \tilde{a}_i$, ($a_0 := a$), 这就导出了

$$a_{i-1} < \tilde{a}_{i-1} \leq a_i < \tilde{a}_i \quad (27)$$

从而得到了 m 个区间的右端点数组 $\tilde{a}_1 < \tilde{a}_2 < \dots < \tilde{a}_m$. 对比 b_i 的定义即知 $\tilde{a}_i = b_i$, 这就导出了不等式 (26). 由此还可以知道, 非退化区间 $I \cap K_n$

可枚举为 $(a_1, b_1), \dots, (a_m, b_m)$. 于是就有

$$\sum_{k=1}^n \ell(I \cap K_n) = \sum_{I \cap K_n \text{ 非退化}} \ell(I \cap K_n) = \sum_{i=1}^m (b_i - a_i) \leq \sum_{i=1}^m (b_i - b_{i-1}) \leq b - a \quad (28)$$

即证明了引理 5.4.

根据引理 5.4, 我们有 $\ell(J_k) \geq \sum_n \ell(J_k \cap I_n)$, 从而有

$$\sum_k \ell(J_k) \geq \sum_k \sum_n \ell(J_k \cap I_n) = \sum_n \sum_k \ell(J_{n,k}) \geq \sum_n \ell(I_n) \quad (29)$$

这就证明了

$$\left| \bigcup_n I_n \right| = \sum_n \ell(I_n) \quad (30)$$

上面这个例子说明 Vitali 的例子多少是有些奇异的. 看起来, 如果集合较为规则, 那么外测度的可加性还是可以成立的. 当然, 找到适当的集类就属于可测空间理论的任务了.

例 5.5. 设 r_1, r_2, \dots 为全体有理数的一个枚举. 令 $F = \mathbb{R} \setminus \bigcup_k (r_k - 2^{-k}, r_k + 2^{-k})$. 证明

1. F 是闭集.
2. F 所包含的区间都是退化的.
3. $|F| = +\infty$.

1. 是平凡的. 至于 2, 设 I 是 F 包含的一个区间, 若 I 非退化, 那么就必定包含一个有理数 r_k 作为其内点, 从而也是 F 的内点. 由 F 的定义可知 r_k 不是 F 的内点, 矛盾! 至于第三条, 则是因为 $\sum_k \ell((r_k - 2^{-k}, r_k + 2^{-k})) = 2$, 因此由 $+\infty = |F \cup (\bigcup_k (r_k - 2^{-k}, r_k + 2^{-k}))| \leq |F| + \sum_k |(r_k - 2^{-k}, r_k + 2^{-k})|$ 即知 $|F| = +\infty$.

6. 可测空间与可测函数 在 Vitali 的例子 (5.1) 中, 只使用到了外测度的以下几条性质:

1. \mathbb{R} 的任意子集的外测度均有定义.
2. 开区间的外测度等于其长度.
3. 外测度具有次可数可加性.
4. 外测度与集合的包含关系相容.
5. 外测度具有平移不变性.

其中性质 4. 实际上可从性质 3. 推出. 自然, 对于任何一个定义在 \mathbb{R} 的子集簇上的 $[0, +\infty]$ 值函数 μ , 只要其同时满足上述五条性质, 那么它就不可能满足有限可加性, 遑论可数可加性. 因而为了获得可加性, 势必要作出一些妥协. 由于后 4 条性质与几何直觉以及分析的需要密切相关, 因此最容易放弃的就是第 1 条, 也即限制 μ 的定义域, 选择一些较小的集类. 由此引入的 σ -代数恐怕就是测度论中最为重要的概念了, 没有之一.

所谓 X 上的一个 σ -代数就是指一个包含集合 X 本身, 且对补集运算和可数并封闭的 X 的子集类. 自然, 其对有限并、有限交和可数交也封闭.

例 6.1. X 的所有至多可数子集, 以及补集为至多可数集的子集, 构成 X 上的一个 σ -代数 \mathcal{S} .

首先, $X \in \mathcal{S}$. 其次, 显然 \mathcal{S} 对补集运算封闭. 最后, 设 $\{E_n\}_{n \in \mathbb{N}}$ 为 \mathcal{S} 中的一列集合, 那么若 E_n 均至多可数, 则 $\bigcup_n E_n$ 当然也至多可数. 否则, 必定存在某个 E_n , 其补集至多可数. 于是 $[\bigcup_n E_n]^C = \bigcap_n E_n^C$ 至多可数. 这就证明了 \mathcal{S} 关于有限并的封闭性.

由于 σ -代数的定义只涉及对 X 的子集簇的集论运算操作的描述, 因而容易验证 X 上任意一族 σ -代数的交集仍然做成一个 σ -代数. 这就导

致了由 X 的任意子集类 \mathcal{A} 所生成的最小 σ -代数 $\sigma(\mathcal{A})$ 的概念. 这不过就是一切包含 \mathcal{A} 的 X 上 σ -代数之交集. 和其他诸多“由某某元素所生成的最小结构”的概念一样, 通常我们只能从集类运算的一般性质的角度了解 \mathcal{A} 所生成的 σ -代数, 而其具体结构的揭示往往是困难的.

例 6.2. X 的一切单点子集所组成的集类 $\mathcal{A} = \{\{x\} \mid x \in X\}$ 所生成的 σ -代数恰好等于例 (6.1) 中的 \mathcal{S} .

首先, 由于 σ -代数 $\sigma(\mathcal{A})$ 包含了所有单点集, 因而显然有 $\mathcal{S} \subset \sigma(\mathcal{A})$. 另一方面, 由于 \mathcal{S} 本身也是一个包含了 \mathcal{A} 的 σ -代数, 因此由集类所生成的 σ -代数之定义即知 $\sigma(\mathcal{A}) \subset \mathcal{S}$, 故这就证明了 $\sigma(\mathcal{A}) = \mathcal{S}$.

最为重要的一个 σ -代数恐怕就是 \mathbb{R} 上的全体开集所生成的 σ -代数, 即 Borel 代数 \mathcal{B} . 可以证明 \mathbb{R} 的开子集都可表示为开区间的可数并, 因此 Borel 代数亦可由 \mathbb{R} 上的全体开区间生成.

一个集合 X 连同其上的一个 σ -代数 \mathcal{S} 就做成一个可测空间 (X, \mathcal{S}) . 可测空间的结构自然完全由 σ -代数 \mathcal{S} 所决定. 这种精巧定义了的集类将为之测度的大展身手提供了基本舞台. σ -代数 \mathcal{S} 中的元素也就摇身一变有了一个新名字, 即 \mathcal{S} -可测集.

与可测空间同样重要的一个概念就是可测函数. 给定了可测空间 (X, \mathcal{S}) , 那么说函数 $f: X \rightarrow [-\infty, +\infty]$ 是可测的, 就是说对于任意 Borel 可测集 B , 其原像 $f^{-1}(B)$ 均落到 σ -代数 \mathcal{S} 中. 这就是说 $f^{-1}(\mathcal{B}) \subset \mathcal{S}$.

以下是一些五花八门的可测函数判别准则以及构作可测函数的基本方法, 这些结论可以为可测函数的判定提供极大的便利.

参考文献

- [1] Sheldon Axler. *Measure, Integration & Real Analysis*. Springer, 2020.
- [2] 任佳刚 and 巫静. 测度与概率教程. 科学出版社, 2018.
- [3] 梅加强. 数学分析. 高等教育出版社, 2011.
- [4] 袁震东. 近代概率引论: 测度、鞅和随机微分方程. 科学出版社, 1991.